



Технологии
Доверия

Цифровой тренинг «Основы моделирования и валидации»

обеспечивает комплексное понимание
процессов моделирования и валидации
в банках



Экспертиза

Курс разработан профессиональными консультантами в области управления рисками совместно с руководителем валидации одного из крупнейших банков России



Удобный доступ

Контент полностью готов и доступен для сотрудников как на платформе TeDo, так и может быть интегрирован через SCORM пакеты во внутреннюю LMS-систему компании

Практика

Практические задания после каждого модуля позволяют оперативно интегрировать полученные знания в работу. Финальное тестирование помогает проверить полученные знания



Основы моделирования и валидации



Базовая программа:

Для кого

Для тех, кто хочет ознакомиться с основами моделирования, получить понимание о лучших практиках организации жизненного цикла моделей в банках:

- заказчики моделей (бизнес-подразделения);
- поддерживающие подразделения (BI, IT, внутренний аудит)

Модуль 1

Что такое модели и зачем они нужны в банке 2 ч.

Модуль 2

Как работают модели в банке: жизненный цикл моделей 2 ч.

Модуль 3

Практика работы моделей в банке: «от провала к прорыву» 1 ч.

Модуль 4

Финальное тестирование 1 ч.

Демо-доступ

6 ч. Примерное время прохождения:

Стоимость:

1 500 000 без НДС
Корпоративное решение

25 000 без НДС
Персональный доступ

Расширенная программа:

Для кого

Для сотрудников, которые вовлечены в процессы валидации и мониторинга, но не полностью понимают процесс в целом, либо его отдельные аспекты, включая:

- junior-специалистов подразделений валидации и моделирования;
- сотрудников внутреннего аудита;
- ML-OPS специалистов

Модуль 1

Что такое модели и зачем они нужны в банке 2 ч.

Модуль 2

Как работают модели в банке: жизненный цикл моделей 2 ч.

Модуль 3

Вероятностные модели с бинарным исходом. Практическая разработка модели в Python 2 ч.

Модуль 4

Валидация и мониторинг моделей 3 ч.

Модуль 5

Практика работы моделей в банке: «от провала к прорыву» 1 ч.

Модуль 6

Финальное тестирование 1 ч.

Демо-доступ

11 ч. Примерное время прохождения:

Стоимость:

2 700 000 без НДС
Корпоративное решение

50 000 без НДС
Персональный доступ

Корпоративное решение

Безлимитный доступ для всех сотрудников банка, представляется как на платформе TeDo, так и может быть интегрирован через SCORM пакеты во внутреннюю LMS-систему компании

Персональный доступ

Стоимость для одного слушателя, прохождение на платформе TeDo

Курс разработали:



Вера Перевицкая

руководитель валидации
одного из крупнейших банков России

- Более 15 лет работы в риск-менеджменте, из которых 12 лет в валидации.
- Организация функций валидации и управления модельным риском для всех областей применения в банковской деятельности, начиная от кредитного риска до кибербезопасности и чат-ботов



Екатерина Кузьмина

старший менеджер, управление финансовыми
рисками, «Технологии доверия»

- Более 11 лет опыта оказания услуг компаниям финансового сектора, включая аудит и консультационные услуги в области управления финансовыми рисками
- Оказание методологической поддержки при разработке и валидации регуляторных моделей для Банков Топ-5



Алия Касымалиева

менеджер, управление финансовыми рисками,
«Технологии доверия»

- Более 6 лет опыта оказания услуг компаниям финансового сектора, включая аудит и консультационные услуги в области управления финансовыми рисками
- Проведение валидации и разработка моделей для банков Топ-10
- Практика валидации моделей европейских банков

По вопросам приобретения курса
можно обратиться:

Екатерина Кузьмина
+7 (963) 978 32 12



Технологии
Доверия



Базовая программа

О чем модуль?

Состав

Модуль 1

Что такое модели и зачем они нужны в банке

Какие преимущества Банк может получить при использовании моделей:

- для бизнеса
- доходности
- более точной оценки риска
- усовершенствования процессов планирования

- Определение модели и моделирования
- Примеры практического применения моделей в банке
- Преимущества и вызовы использования моделей
- Участие моделей в бизнес-процессах банка
- Типология моделей
- Основные методы моделирования
- Характеристики моделей

Модуль 2

Как работают модели в банке: жизненный цикл моделей

- Как живет любая модель в банке: начиная от появления идеи, до внедрения модели в процессы
- Основные участники процесса и их функции

- Выявление потребностей и постановка задачи
- Подготовка данных для моделирования. Источники данных
- Инфраструктура и среда для разработки модели
- Согласование результатов модели
- Валидация и внедрение модели
- Жизнь после внедрения

Модуль 3

Практика работы моделей в банке: «от провала к прорыву»

- Реальные практические ситуации, когда что-то в моделировании или использовании модели идёт не так, и примеры решений таких ситуаций

- В каких случаях нецелесообразно разрабатывать модель
- Модельный риск и влияние операционных ошибок на внедрение модели
- Ограничения, которые стоит учесть во время использования моделей
- Главный секрет успешного моделирования

Модуль 4

Финальное тестирование

- Проверка того, насколько хорошо был усвоен материал

Расширенная программа

О чем модуль?

Состав

Модуль 1

Что такое модели и зачем они нужны в банке

Какие преимущества Банк может получить при использовании моделей:

- для бизнеса
- доходности
- более точной оценки риска
- усовершенствования процессов планирования

- Определение модели и моделирования
- Примеры практического применения моделей в банке
- Преимущества и вызовы использования моделей
- Участие моделей в бизнес-процессах банка
- Типология моделей
- Основные методы моделирования
- Характеристики моделей

Модуль 2

Как работают модели в банке: жизненный цикл моделей

- Как живет любая модель в банке: начиная от появления идеи, до внедрения модели в процессы
- Основные участники процесса и их функции

- Выявление потребностей и постановка задачи
- Подготовка данных для моделирования. Источники данных
- Инфраструктура и среда для разработки модели
- Согласование результатов модели
- Валидация и внедрение модели
- Жизнь после внедрения

Модуль 3

Вероятностные модели с бинарным исходом. Практическая разработка модели в Python.

- Разработка модели вероятности дефолта в Python

- Создание длинного списка переменных
- Выбор методов обучения
- Формирование обучающей и тестовой выборки
- Отбор переменных
- Подбор гиперпараметров
- Обучение модели
- Оценка качества модели

Расширенная программа



О чем модуль?

Состав

Модуль 4

Валидация и мониторинг моделей

- Теория проведения валидации и мониторинга моделей и практические кейсы оценки качества модели

- Цели и задачи валидации
- Отличие валидации и мониторинга
- Регуляторные требования к валидации моделей
- Состав валидации: методологический и количественный анализ
- Проведение статистических тестов в рамках валидации
- Альтернативное моделирование. Составление валидационного отчета
- Расчет метрик качества моделей в Python

Модуль 5

Практика работы моделей в банке: «от провала к прорыву»

- Реальные практические ситуации, когда что-то в моделировании или использовании модели идёт не так, и примеры решений таких ситуаций

- В каких случаях нецелесообразно разрабатывать модель
- Модельный риск и влияние операционных ошибок на внедрение модели
- Ограничения, которые стоит учесть во время использования моделей
- Главный секрет успешного моделирования

Модуль 6

Финальное тестирование

- Проверка того, насколько хорошо был усвоен материал

